Ministère des Finances 2007-04076/

Communiqué

Diffusion à 8 h 15 HNE

Ottawa, le 3 novembre 2006
2006-062

Réserves officielles de liquidités internationales

Le ministère des Finances a annoncé aujourd'hui que les réserves officielles de liquidités internationales du Canada ont augmenté en octobre d'un montant équivalant à 374 millions de dollars américains, pour s'établir à 35 643 millions de dollars américains.

Des détails sur le niveau et la composition des réserves de liquidités du Canada au 31 octobre 2006, ainsi que sur les principaux facteurs qui sous-tendent l'évolution des réserves, figurent ci-après. Tous les chiffres sont en millions de dollars américains, sauf avis contraire.

Réserves de liquidités en devises

Titres	29 712
Dépôts	3 976
Total – Titres et dépôts (réserves de liquidités)	33 688
Or[1]	66
Droits de tirage spéciaux (DTS)	944
Position de réserve au FMI	945
Total : 31 octobre 2006	35 643
30 septembre 2006	36 017
Variation nette	-374

Détails de la variation nette

Opérations de gestion des réserves[2]	-452
Gains ou pertes sur les ventes d'or	0
Gains ou pertes sur le montant net des placements	
Revenus de placements[3]	107
Frais de la dette en devises	-150
Effet des réévaluations[4]	121
Opérations nettes du gouvernement[5]	0
Interventions officielles	0
Autres opérations	0
Variation nette	-374

Détails sur les dépôts

Autres banques centrales et Banque des règlements internationaux		572
Banques ayant leur siège au Canada		0
dont : installées à l'étranger	0	
Banques ayant leur siège à l'étranger		3 404
dont : installées au Canada	0	
Total		3 976

Composition par devise des dépôts et titres

Dollar américain	16 256
Euro	16 921
Yen	511
Total	33 688

Gouvernement du Canada / Government of Canada

Canada

Pertes à court terme prédéterminées sur les réserves en devises (valeur nominale)

		0-1 mois	1-3 mois	3-12 mois	Total
Titres en devises[6]	Principal	-908	-1 216	-1 864	-3 988
	Intérêts	-68	-225	-1 104	-1 397
Positions totales à court terme en devises sur le dollar canadien		0	0	0	0
Positions totales à long terme en devises sur le dollar canadien		0	0	0	0
Total – Pertes sèches		-976	-1 441	-2 968	-5 385

Renseignements supplémentaires (valeur nominale)

Solde des marges de crédit inconditionnelles non utilisées auprès des banques ayant leur siège à l'étranger	6 000
Titres prêtés aux termes d'engagements de rachat[7]	-2 218
Titres détenus aux termes d'engagements de rachat[8]	2 201
Produits dérivés (nets, évalués à la valeur du marché)	
Contrats à terme négociés de gré à gré	0
Swaps	2 872

Remarques :

1. Il n'y a eu aucune vente d'or réglée en octobre. Au 31 octobre, les réserves d'or s'établissaient à 0,1 million d'onces. L'évaluation est fondée sur le fixing de Londres du 31 octobre 2006, en après-midi, de 603,75 $US l'once.

2. Variation nette au chapitre des titres et des dépôts découlant d'activités de financement du gouvernement en devises (l'émission d'obligations en devises utilisées pour acquérir des actifs accroît les réserves, tandis que les titres à échéance les réduisent). En octobre, les bons du Canada ont diminué d'un montant équivalant à 89 millions de dollars américains, les bons en circulation représentant 1 673 millions de dollars américains. Les swaps de devises des obligations canadiennes ont augmenté d'un montant équivalant à 301 millions de dollars américains. Il y a eu échéance d'un montant équivalant à 664 millions de dollars américains de swaps de devises des obligations canadiennes.

3. Les « revenus de placements » sont composés de 103 millions de dollars américains de revenus d'intérêts et d'une augmentation de 4 millions de dollars américains de la valeur marchande des titres, variation qui découle de la fluctuation des taux d'intérêt.

4. L'« effet des réévaluations » tient compte des changements de la valeur marchande des actifs des réserves causés par les fluctuations des taux de change. En octobre, l'effet des réévaluations a été principalement dû à l'appréciation de l'euro.

5. Les « opérations nettes du gouvernement » désignent les achats nets de devises pour répondre aux besoins du gouvernement en devises et regarnir les réserves.

6. Les « titres en devises » comprennent les emprunts en devises venant à échéance, les paiements au titre des swaps de devises et une estimation des paiements d'intérêt sur les passifs en devises.

7. Les « titres prêtés aux termes d'engagements de rachat » sont inclus dans le total des réserves. Les biens affectés en garantie pour les opérations de prêt de titres ne sont pas inclus dans le total des réserves.

8. Les montants en espèces investis aux termes d'engagements de rachat sont inclus dans le total des réserves. Les biens affectés en garantie pour les opérations de prêt de titres ne sont pas inclus dans le total des réserves.

Prochaines dates de parution

Les prochains résultats seront publiés le 5 décembre 2006 (visant la période de novembre 2006).

Une liste des prochaines dates de parution est affichée sur le site Web du ministère des Finances à : www.fin.gc.ca/invest_x/releaseDates_f.asp.

Pour plus de renseignements, les médias peuvent communiquer avec :

Clifton Lee-Sing
Division des marchés financiers
Ministère des Finances
613-943-1944

David Gamble
Relations avec les médias
Ministère des Finances
613-996-8080

www.fin.gc.ca

Pour plus de renseignements sur le Compte du fonds des changes, veuillez consulter le *Rapport sur la gestion des réserves officielles de liquidités internationales du Canada du 1er janvier 2005 au 31 mars 2006* à l'adresse : www.fin.gc.ca/tocf/2006/oir06_f.thml.

Si vous désirez recevoir un courriel vous avisant automatiquement à chaque émission d'un communiqué de presse, veuillez visiter le site Web du ministère des Finances à l'adresse suivante : www.fin.gc.ca/scripts/register_f.asp.

Réserves officielles de liquidités internationales (synthèse de 10 ans)

	Dollars américains	Autres devises	Or	DTS	Position au FMI	Total
			(en millions de dollars américains)			
31 octobre 2006	16 256	17 432	66	944	945	35 643
30 septembre 2006	16 755	17 166	65	941	1 090	36 017
31 août 2006	17 010	16 727	68	949	1 099	35 853
31 juillet 2006	17 712	16 572	69	942	1 096	36 391
30 juin 2006	17 671	16 143	67	939	1 092	35 912
31 mai 2006	17 846	15 715	71	949	1 103	35 684
30 avril 2006	18 660	14 997	70	931	1 058	35 716
31 mars 2006	20 204	13 812	63	917	1 038	36 034
28 février 2006	16 707	13 974	61	908	1 034	32 684
31 janvier 2006	16 813	14 135	62	907	1 042	32 959
31 décembre 2005	16 842	13 822	56	897	1 401	33 018
30 novembre 2005	16 646	14 566	54	894	2 039	34 199
31 octobre 2005	16 909	14 214	51	898	2 142	34 214
31 décembre 2004	14 426	15 740	48	925	3 327	34 466
31 décembre 2003	15 575	15 961	45	838	3 848	36 267
31 décembre 2002	17 946	14 739	205	712	3 567	37 169
31 décembre 2001	19 748	10 736	291	614	2 859	34 248
31 décembre 2000	21 692	7 327	323	574	2 508	32 424
31 décembre 1999	18 838	5 594	524	526	3 164	28 646
31 décembre 1998	15 907	4 004	122	1 097	2 297	23 427
31 décembre 1997	14 630	492	146	1 126	1 575	17 969
31 décembre 1996	17 521	507	155	1 168	1 227	20 578
31 décembre 1995	12 127	502	178	1 177	1 243	15 227